

Fecha de Publicación: 30 de Septiembre de 2005
Fecha de Información: 28 de Septiembre de 2005 ¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$144,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de $-0,3\%$.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	45,0	40,8	1,8	6,0	46,8
15-35	31,8	30,3	23,3	24,8	55,1
36-60	9,0	5,3	0,3	4,0	9,3
61-90	13,5	16,5	14,5	11,5	28,0
91-180	0,6	3,3	3,3	0,6	3,9
>180	1,0	0,3	0,3	1,0	1,3
Total	100,9	96,5	43,4	47,9	144,4

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	-0,2 %	-2,0 %
15-35	0,3 %	0,2 %
36-60	1,2 %	1,3 %
61-90	0,5 %	0,5 %
91-180	1,3 %	1,3 %
>180	2,1 %	1,2 %
Total	0,5 %	-0,3 %

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.³

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	26 al 30 de Septiembre				3 al 7 de Octubre				10 al 14 de Octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	6	77	677	587	12	79	704	413	12	137	383	251
Real	77	5	311	401	79	12	101	391	135	11	109	240
Total	82	82	988	988	91	91	805	805	148	148	492	492

* Cifras en millones de dólares

¹ Datos provisionales.

² La fórmula para la devaluación implícita es: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Promedio SET FX}) \wedge (365/\text{Plazo})) - 1$

³ A partir del 29 de septiembre se presenta la proyección de vencimientos.